第一图书网, tushu007.com

<<信用风险控制理论研究>>

图书基本信息

书名：<<信用风险控制理论研究>>

13位ISBN编号：9787802075399

10位ISBN编号：7802075394

出版时间：2006-12

出版时间：经济管理出版社

作者：吴恒煜

页数：249

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：http://www.tushu007.com

第一图书网, tushu007.com

内容概要

本书是在现代金融理论的基础上，对信用风险违约概率测度与信用衍生品定价理论进行系统的、前瞻性的研究，对提高我国金融市场竞争力、增强金融安全，完善金融市场体系有重要作用，而且符合建设多层次资本市场的基本要求。

作者简介

吴恒煜，中山大学管理学院金融学博士后（2006）、西安交通大学管理学院管理学博士（2002），金融工程教授，硕士生导师，现任职于江西财经大学金融学院证券期货研究所副所长，先后在《经济学动态》、《系统工程学报》、《管理工程学报》、《系统工程》等学术刊物上发表30多篇学术论文。
现主要研究方向为利率期限结构、信用风险控制与管理、金融衍生品定价。

书籍目录

第一章　绪论一、金融全球化中我国商业银行实施信用风险管理的必要性二、商业银行信用风险管理的关键——违约概率测度三、信用风险管理的重要手段——信用衍生品四、本书结构第二章　期权定价理论及其在公司财务结构定价中的应用一、引言二、期权定价理论的早期发展三、布莱克一斯科尔斯（B1ack-Scholes）公式及其假设四、布莱克一斯科尔斯（B1ack-Scholes）公式的推导五、布莱克一斯科尔斯（B1ack-Scholes）公式的推广六、期权定价理论在公司财务结构定价中的应用七、小结第三章　连续时间利率期限结构模型一、引言二、基本定义三、单因子均衡模型四、多因子均衡模型五、仿射类模型（或指数仿射模型）六、单因子校准模型七、Heath、Jarrow和Morton（HJM）模型八、两要素利率期限结构的债券期权定价九、小结第四章　有违约风险权益定价理论一、引言二、结构化模型三、约化模型四、有违约风险权益的一般化定价模型五、模型的扩展与进一步的研究方向第五章　基于KMV模型的上市公司信用风险违约概率度量一、引言二、信用风险的KMV模型三、上市公司信用风险的实证分析四、KMV模型的优点与存在的问题附录：SAS Code to Calculate BSM—Prob第六章　结构化模型中违约概率的比较静态分析及实证一、引言二、以期权理论为基础的违约模型三、风险债务违约概率的参数计算四、违约概率的比较静态分析五、模型的实证分析六、数值算例七、小结第七章　主要的信用衍生产品及其定价模型一、引言二、主要的信用衍生产品三、几种信用衍生品的定价四、小结第八章　随机挽回率马尔可夫链模型下信用差价衍生品定价一、引言二、Jarrow，Lando和Turnbull（1997）（JLT）模型三、随机挽回率下JLT模型的扩展四、信用差价期权定价五、小结第九章　具有价格均值回复与随机波动率的信用差价衍生产品定价一、引言二、一般均值回复模型与特征函数三、随机波动率模型四、信用差价期权、上限与下限的定价五、小结第十章　基于跳一扩散过程的公司债务证券定价一、引言二、基本模型描述三、公司债务定价四、从属债券定价五、信用差价期权定价六、小结附录第十一章　具有违约风险的欧式期权定价一、引言二、一般模型三、模型特例附录第十二章　不完全市场下有违约风险的欧式期权定价一、引言二、期权的基础资产与交易对手的资产均为不可交易时的一般模型三、特别情形四、小结附录参考文献

第一图书网, tushu007.com

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:http://www.tushu007.com